Deutscher Bundestag **Drucksache 18/9731**
18. Wahlperiode 21.09.2016

Kleine Anfrage

der Abgeordneten Dr. Gerhard Schick, Kerstin Andreae, Lisa Paus, Britta Haßelmann, Dr. Thomas Gambke, Sven-Christian Kindler, Corinna Rüffer und der Fraktion BÜNDNIS 90/DIE GRÜNEN

Transaktionsdatenauswertung durch die Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht

Gemäß § 9 des Wertpapierhandelsgesetzes (WpHG) besteht eine Meldepflicht für Wertpapierdienstleistungsunternehmen und Zweigniederlassungen im Sinne des § 53b des Kreditwesengesetzes (KWG) an die Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin) über jedes Geschäft in Finanzinstrumenten, die zum Handel an einem organisierten Markt zugelassen oder in den regulierten Markt oder den Freiverkehr einer inländischen Börse einbezogen sind. Eingeschlossen in die Meldepflicht sind auch die außerbörslichen Over The Counter (OTC) Geschäfte. Der BaFin stehen umfassende Informationen in Bezug auf die vorgenannten Transaktionen zur Verfügung.

Wir fragen die Bundesregierung:

1. Wertet die BaFin die oben genannten Transaktionsdaten fortlaufend aus, und wenn ja, wie, und mit welchen Zielen?
2. Lassen die der BaFin zur Verfügung stehenden Transaktionsdaten Rückschlüsse über unterschiedliche Arten von Handelsgeschäften (Inbound, Leerverkauf etc.) zu?

   Wenn ja, welche Differenzierungen nimmt die BaFin in ihren Auswertungen diesbezüglich vor?
3. Unter welchen Umständen nimmt die BaFin außerordentliche Auswertungen dieser Daten vor?

   Ist dies – und wenn ja, unter welchen Umständen – in den Jahren 2002 bis 2016 vorgekommen?
4. Unter welchen Umständen kann eine andere staatliche Behörde der Bundes- oder Landesebene die BaFin zu einer Auswertung der Transaktionsdaten veranlassen?

   Ist dies – und wenn ja, unter welchen Umständen – in den Jahren 2002 bis 2016 vorgekommen?
5. Unter welchen Umständen kann eine andere staatliche Behörde der Bundes- oder Landesebene auf die oben genannten Transaktionsdaten Zugriff erhalten?

   Ist dies – und wenn ja, unter welchen Umständen – in den Jahren 2002 bis 2016 vorgekommen?

6. In welchem Handelsvolumen wurden zwischen den Jahren 2002 und 2016 im Inland Wertpapiere oder darauf basierte Derivate um den Tag der Dividendenausschüttung (+/− 2 Tage) der jeweiligen Aktiengesellschaft gehandelt, und wie hoch war im Gegensatz dazu das Handelsvolumen an einem durchschnittlichen Handelstag, der außerhalb des Zeitfensters um den Dividendenstichtag liegt (bitte für DAX 30 angeben)?

7. Wurde der Unterschied zwischen dem Handelsvolumen um den Dividendenstichtag und dem durchschnittlichen Handelsvolumen an einem Tag, der außerhalb des Zeitfensters um den Dividendenstichtag liegt, von einer Behörde des Bundes analysiert?

   Wenn ja, mit welchem Ergebnis (diese Frage bezieht sich auf DAX 30)?

8. Wurden auffällige Veränderungen der Handelsvolumina um den Dividendenstichtag von Jahr zu Jahr zwischen 2002 und 2016 festgestellt?

   Wenn ja, welche, und wie erklärt sich die Bundesregierung diese Veränderungen (diese Frage bezieht sich auf DAX 30)?

9. In welchen Fällen führten in den Jahren 2002 bis 2016 Analysen der BaFin in Bezug auf Handelsvolumina um den Dividendenstichtag zu behördlichen – auch behördeninternen – Prüfungen, Ermittlungen oder sonstigen Maßnahmen?

10. Welcher Art und welchen Inhalts waren vorgenannte Maßnahmen, und zu welchem Ergebnis führten sie?

11. In welchem Maße (bitte quantifizieren bzw. schätzen) hat sich nach Erkenntnissen der BaFin das Transaktionsvolumina um den Dividendenstichtag in den Jahren 2007 bis 2011 im Verhältnis zu den Jahren 2002 bis 2006 verändert?

12. Inwieweit waren nach Ansicht der Bundesregierung die Einführung der Regelungen gegen die mehrfache Anrechnung von Kapitalertragsteuern mit dem Jahressteuergesetz 2007 ab dem Jahr 2007 ursächlich für eine Veränderung der Transaktionsvolumina um den Dividendenstichtag im Vergleich zu den Vorjahren zwischen 2002 und 2006?

13. In welchem Maße (bitte quantifizieren bzw. schätzen) hat sich nach Erkenntnissen der BaFin das Transaktionsvolumina um den Dividendenstichtag im Jahr 2012 und den Folgejahren im Verhältnis zu den Jahren 2002 bis 2011 verringert?

14. Inwieweit war die Umsetzung der OGAW-IV-Richtlinie nach Ansicht der Bundesregierung ab dem Jahr 2012 ursächlich für eine Veränderung der Transaktionsvolumina um den Dividendenstichtag im Vergleich zu den Vorjahren ab 2002?

15. Sofern es in einem oder mehreren der Jahre 2002 bis 2016 zwar zu einem signifikanten Anstieg des Transaktionsvolumen um den Dividendenstichtag kam, nicht aber zu behördlichen Maßnahmen kam, warum nicht?

16. In wie vielen Fällen hat die BaFin in den Jahren 2002 bis 2016 AIF-KVG-Lizenzen oder InvAG-Lizenzen nicht gewährt, weil die antragstellenden Fonds eine Cum-Ex Strategie verfolgt haben.

17. War die Erteilung solcher Lizenzen in den Jahren 2002 bis 2016 Teil von schriftlicher oder mündlicher Kommunikation zwischen dem Bundesministerium der Finanzen (BMF) und der BaFin?

    Wenn ja, in welchen Jahren, und in wie vielen Fällen?

18. In wie vielen Fällen hat die BaFin in den Jahren 2002 bis 2016 AIF-KVG-Lizenzen oder InvAG-Lizenzen nicht gewährt, weil die antragstellenden Fonds eine Dividendenstrippingstrategie (auch genannt: Dividendenarbitrage, Cum-Cum, Dividendenstrategie) verfolgt haben?
19. War die Erteilung solcher Lizenzen in den Jahren 2002 bis 2016 Teil von schriftlicher oder mündlicher Kommunikation zwischen dem BMF und der BaFin?

    Wenn ja, in welchen Jahren, und in wie vielen Fällen?

Berlin, den 21. September 2016

Katrin Göring-Eckardt, Dr. Anton Hofreiter und Fraktion



Satz: Satzweiss.com Print, Web, Software GmbH, Mainzer Straße 116, 66121 Saarbrücken, www.satzweiss.com
Druck: Printsystem GmbH, Schafwäsche 1-3, 71296 Heimsheim, www.printsystem.de
Vertrieb: Bundesanzeiger Verlag GmbH, Postfach 10 05 34, 50445 Köln, Telefon (02 21) 97 66 83 40, Fax (02 21) 97 66 83 44, www.betrifft-gesetze.de
ISSN 0722-8333